



Faculté des sciences économiques, sociales et politiques

ESPO

ACTU3813 **Calcul stochastique et application à l'assurance et à la finance II**

[30h] 4.5 crédits

Enseignant(s): Pierre Ars, Pierre Devolder
Langue d'enseignement : français
Niveau : cours de 3ème cycle

Objet de l'activité (principaux thèmes à aborder)

Familiariser les étudiants avec les théories actuarielles basées sur des techniques mathématiques avancées et ne rentrant pas dans le cadre d'autres cours.

Résumé : Contenu et Méthodes

CONTENU

Plusieurs théories actuarielles sont difficilement applicables en pratique parce que l'actuaire ignore les distributions statistiques sur lesquelles elles se basent. Le cours montre comment une information fragmentaire sur ces distributions (moments, unimodalité,...) permet néanmoins d'arriver à des résultats pratiques.

En complément, d'autres théories actuarielles récentes peuvent éventuellement être développées dans les cours.

METHODE

Cours magistral assorti d'exercices théoriques.

Autres crédits de l'activité dans les programmes

ACTU22MS	Deuxième année du master en sciences actuarielles, à finalité spécialisée	(4.5 crédits)	Obligatoire
ACTU3DS	Diplôme d'études spécialisées en sciences actuarielles	(4.5 crédits)	Obligatoire